

短期市場の推移

[億円] [%]

	9月7日	9月8日	9月9日	9月10日
加重平均金利	▲0.064	▲0.066	▲0.070	▲0.073
東京レポレート(ON)	▲0.127	▲0.167	▲0.104	▲0.094
無コール残	85,037	94,118	86,748	87,786
ON	47,419	54,160	47,350	49,368
その他	37,618	39,958	39,398	38,418
有コール残	17,450	17,855	21,609	25,091

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの。無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.087	0.001	▲0.074	▲0.102
T/N	-	-	▲0.001	▲0.108
S/N	-	-	-	-
1W	-	-	▲0.040	▲0.108
2W	-	-	-	▲0.110
3W	-	-	-	▲0.118
1M	-	-	-	▲0.120
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.121
6M	-	-	-	▲0.145
1Y	-	-	-	▲0.164

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

9月14日の予定(時刻は日本時間)

	日本	予想	海外	予想
10:00	営業毎旬報告 (9月10日現在)	-	18:30 (欧)7月鉱工業生産指数 [前月比]	2.7%
13:30	7月の第3次産業活動 (経産省)	-	IAEA理事会 (18日まで、ウイーン)	-
13:30	7月の鉱工業生産・確報 (経産省)	-	-	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.075%の合出から始まり、その後は主に▲0.087%~▲0.035%の水準で合出が見られた。3日積みではあるが調達に動く先は限定的で、引き続き軟調な地合いとなった。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.074%となり、昨年11月以来の10か月ぶりの低水準となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.087 ~ ▲0.087	▲0.080 ~ ▲0.035

翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達姿勢に大きな変化はなく、合出水準は概ね横ばいを予想。

資金需給

[億円]

	日銀速報	日銀予想	当社需給予想
	9月11日	9月14日	9月15日
券	+500	+200	+0
財政	▲12,500	▲26,600	▲2,000
過不足	▲12,000	▲26,400	▲2,000
金融調節	エンド	スタート	エンド
国債買入		+12,000	
CP等買入	▲1,200	▲900	
社債等買入	▲100	▲100	
ETF買入		+700	
国債補完供給	+100	+100	
米ドル資金供給用担保国債供給		+9,000	
当座預金増減	▲10,300	▲5,600	▲2,000
当座預金残高	4,578,000	4,572,400	4,570,400
準備預金残高	3,936,700	主な需給要因	
積み終了先	3,936,600		
超過準備	3,936,600		
非準備先残高	641,300		
準備金進捗率	100.0%		
平均	93.5%		
乖離率	6.5%		

9月11日のオペ結果 [%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	按分
国債買入(9/14~)						
1~3年	4,200	6,913	4,201	▲0.010	▲0.001	16.0
3~5年	3,500	9,229	3,504	▲0.005	▲0.004	17.8
5~10年	4,200	11,059	4,210	▲0.007	▲0.005	14.4
国債補完供給(9/11~9/14)						
	55	55	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マネタリーベース [億円]
9月10日時点 5,771,200

所要 [億円]
今積期の所要準備額 3,516,000
9月14日以降の残リ所要
積数 0
平均 0

国庫短期証券入札予定

9月16日	1年	第937回
9月18日	3ヶ月	第938回
9月24日	6ヶ月	
9月25日	3ヶ月	
国債入札予定		
9月24日	40年	
9月29日	2年	
10月1日	10年	
10月6日	30年	

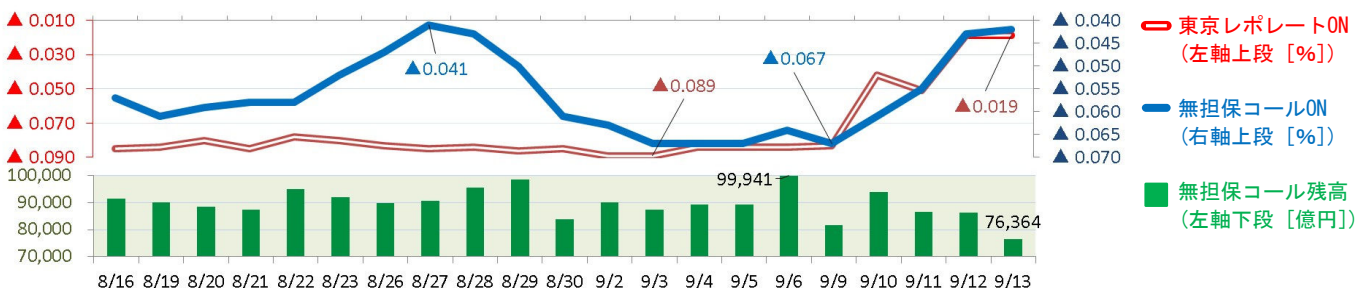
今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	500~1,500	1,000	月3回程度	9月4日	2
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	2 7 11 16 23 28	9月11日	3
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	2 7 11 16 23 30	9月11日	3
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	4 11 16 23 28	9月11日	3
10年超25年以下	500~2,000	1,200	2 14	9月2日	1
25年超	0~500	300	7 28	9月7日	1
物価連動債	300	300	月2回程度	8月28日	2
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	月1回	8月5日	1

1年前の市場推移

○2019年8月積み期 [8月16日~9月13日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。